华宝量化对冲策略混合型发起式证券投资基金招募说明书（更新）摘要

2018年第1号

基金管理人：华宝基金管理有限公司
基金托管人：中国银行股份有限公司
重要提示

本基金根据2014年7月23日中国证券监督管理委员会证监许可［2014］737号的注册，进行募集。

基金管理人保证《华宝量化对冲策略混合型发起式证券投资基金招募说明书》(以下简称“招募说明书”或“本招募说明书”)的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会注册，但中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

本基金为特殊类型的混合型基金，主要采用追求绝对收益的市场中性策略，与股票市场表现的相关性较低。相对股票型基金和一般的混合型基金，其预期风险较小。本基金实际的收益和风险主要取决于基金投资策略的有效性，因此收益不一定能超越业绩比较基准。

本基金投资于证券、期货市场，基金净值会因为证券、期货市场波动等因素产生波动，投资者在投资本基金前，需充分了解本基金的产品特性，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：因整体政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险。另外，本基金还将面临市场中性策略产品的风格风险、投资策略有效性风险、量化模型及金融数据的风险、发起式基金自动终止的风险、因投资股指期货面临的杠杆风险、基差风险、展期时的流动性风险、盯市结算制度带来的现金管理风险、到期日风险、对手方风险、连带风险、未平仓合约不能继续持有的风险等特有的风险，详见本招募说明书的风险揭示部分。

投资者在进行投资决策前，请仔细阅读本基金的《招募说明书》及《基金合同》，并根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断基金是否和投资人的风险承受能力相适应。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证投资于本基金一定盈利，也不保证最低收益。本摘要根据《基金合同》和《招募说明书》编写，经基金托管人审核，并经中国证监会核准。《基金合同》是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。投资人自取得依《基金合同》所发售的基金份额，即成为基金份额持有人和《基金合同》当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对《基金合同》的承认和接受，并按照《基金法》、《运作办法》、《基金合同》及其他有关规定享有权利、承担义务；基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅《基金合同》。

本摘要所载内容截止日为2018年3月17日，有关财务数据和净值表现数据截止日为2017年12月31日，财务数据未经审计。

一、基金合同生效日

本基金基金合同生效日：2014年9月17日

二、基金管理人

（一）基金管理人概况

基金管理人：华宝基金管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道100号上海环球金融中心58楼

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道100号上海环球金融中心58楼

法定代表人：孔祥清

总经理：HUANG Xiaoyi Helen（黄小薏）

成立日期：2003年3月7日

注册资本：1.5亿元

电话：021－38505888

联系人：章希

股权结构：中方股东华宝信托有限责任公司持有51%的股份，外方股东Warburg Pincus Asset Management，LP.持有49%的股份。

（二）基金管理人主要人员情况

1、董事会成员

孔祥清先生，董事长，硕士，高级会计师。曾任宝钢计财部资金处主办、主管、副处长，宝钢集团财务有限公司总经理。现任华宝基金管理有限公司董事长、华宝投资有限公司副总经理、法兴华宝汽车租赁（上海）有限公司董事长、华宝信托有限责任公司董事、华宝都鼎（上海）融资租赁有限公司董事长、中国太平洋保险（集团）股份有限公司董事。

HUANG Xiaoyi Helen（黄小薏）女士，董事，硕士。曾任加拿大TD Securities公司金融分析师，Acthop投资公司财务总监。2003年5月加入华宝基金管理有限公司，先后担任公司营运总监、董事会秘书、副总经理，现任华宝基金管理有限公司总经理。

Michael Martin先生，董事，博士。曾任Wachtell Lipton Rosen & Katz律师助理；第一波士顿银行董事总经理；瑞银证券董事总经理；Brooklyn NY Holdings总裁；现任美国华平投资集团全球执行委员会成员、全球金融行业负责人、董事总经理，美国Financial Engines董事、加拿大DBRS董事、美国Mariner Finance董事。

周朋朋先生，董事，本科。曾任瑞士信贷第一波士顿（加拿大）分析师；花旗银行（香港）投资银行部分析师；现任美国华平集团中国金融行业负责人、董事总经理，华融资产管理股份有限公司董事，上海如合投资管理咨询服务有限公司董事。

胡光先生，独立董事，硕士。曾任美国俄亥俄州舒士克曼律师事务所律师、飞利浦电子中国集团法律顾问、上海市邦信阳律师事务所合伙人。现任上海胡光律师事务所主任、首席合伙人。

尉安宁先生，独立董事，博士。曾任宁夏广播电视大学讲师，中国社会科学院经济研究所助理研究员，世界银行农业经济学家，荷兰合作银行东北亚区食品农业研究主管，新希望集团常务副总裁，比利时富通银行中国区CEO兼上海分行行长，山东亚太中慧集团董事长。现任上海合旺投资管理有限公司董事长。

陈志宏先生，独立董事，硕士。曾任毕马威会计师事务所合伙人、普华永道会计师事务所合伙人，苏黎世金融服务集团中国区董事长，华彬国际投资（集团）有限公司高级顾问。

2、监事会成员

朱莉丽女士，监事，硕士。曾就职于美林投资银行部、德意志银行投资银行部；现任美国华平集团执行董事。

杨莹女士，监事，本科。曾在三九集团、中国平安保险（集团）股份有限公司、永亨银行（中国）有限公司、中国民生银行工作，现任华宝投资有限公司风控合规部总经理。

贺桂先先生，监事，本科。曾任华宝信托投资有限责任公司研究部副总经理；现任华宝基金管理有限公司营运副总监。

王波先生，监事，硕士。曾任上海证券报记者；现任华宝基金管理有限公司市场总监兼战略策划部总经理。

3、总经理及其他高级管理人员

孔祥清先生，董事长，简历同上。

HUANG Xiaoyi Helen（黄小薏）女士，总经理，简历同上。

向辉先生，副总经理，硕士。曾在武汉长江金融审计事务所任副所长、在长盛基金管理有限公司市场部任职。2002年加入华宝基金管理有限公司参与公司的筹建工作，先后担任公司清算登记部总经理、营运副总监、营运总监，现任华宝基金管理有限公司副总经理。

欧江洪先生，副总经理，本科。曾任宝钢集团财务部主办、宝钢集团成本管理处主管、宝钢集团办公室（董事会办公室）主管/高级秘书、宝钢集团办公厅秘书室主任、华宝投资有限公司总经理助理兼行政人事部总经理、党委组织部部长、党委办公室主任、董事会秘书等职务。现任华宝基金管理有限公司副总经理。

刘月华先生，督察长，硕士。曾在冶金工业部、国家冶金工业局、中国证券业协会等单位工作。现任华宝基金管理有限公司督察长。

4、本基金基金经理

徐林明先生，复旦大学经济学硕士，FRM，曾在兴业证券、凯龙财经（上海）有限公司、中原证券从事金融工程研究工作。2005年8月加入华宝基金管理有限公司，曾任金融工程部数量分析师、金融工程部副总经理。2009年9月至2015年11月任华宝中证100指数型证券投资基金基金经理，2010年2月起任量化投资部总经理，2010年4月至2015年11月任华宝上证180价值交易型开放式指数证券投资基金、华宝上证180价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，2014年6月任助理投资总监，2014年9月兼任华宝量化对冲策略混合型发起式证券投资基金基金经理。2015年4月起任华宝事件驱动混合型证券投资基金基金经理。2016年12月起兼任华宝沪深300指数增强型发起式证券投资基金基金经理。

5、权益投资决策委员会成员

刘自强先生，投资总监、华宝动力组合混合型证券投资基金基金经理、华宝高端制造股票型证券投资基金基金经理、华宝国策导向混合型证券投资基金基金经理、华宝未来主导产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

闫旭女士，投资总监、国内投资部总经理、华宝行业精选混合型证券投资基金基金经理、华宝收益增长混合型证券投资基金基金经理、华宝稳健回报灵活配置混合型证券投资基金、华宝智慧产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

胡戈游先生，助理投资总监、华宝宝康消费品证券投资基金基金经理、华宝品质生活股票型证券投资基金基金经理、华宝核心优势灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

曾豪先生，研究部总经理，华宝先进成长混合型证券投资基金基金经理。

蔡目荣先生，国内投资部副总经理、华宝多策略增长开放式证券投资基金基金经理、华宝资源优选混合型证券投资基金基金经理。

6、上述人员之间不存在近亲属关系。

（三）基金管理人职责

基金管理人应严格依法履行下列职责：

1、依法募集资金，办理基金份额的发售和登记事宜；

2、办理本基金备案手续；

3、对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账，进行证券投资；

4、按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；

5、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

6、编制中期和年度基金报告；

7、计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回价格；

8、办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项；

9、按照规定召集基金份额持有人大会；

10、保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；

11、以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；

12、中国证监会规定的其他职责。

（四）基金管理人承诺

1、基金管理人将遵守《基金法》、《证券法》等法律法规的相关规定，并建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违法违规行为的发生。

2、基金管理人不从事下列行为：

（1）将其固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；

（2）不公平地对待其管理的不同基金财产；

（3）利用基金财产为基金份额持有人以外的第三人牟取利益；

（4）向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；

（5）依照法律、行政法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他行为。

3、基金经理承诺

（1）依照有关法律法规和基金合同的规定，本着谨慎的原则为基金份额持有人谋取最大利益；

（2）不利用职务之便为自己、代理人、代表人、受雇人或任何其他第三人牟取不当利益；

（3）不泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息；

（4）不以任何形式为其他组织或个人进行证券交易。

（五）基金管理人内部控制制度

1、风险管理体系

本基金在运作过程中面临的风险主要包括市场风险、信用风险、流动性风险、操作风险、合规性风险、信誉风险和事件风险（如灾难）以及本基金其他特有风险，详见本招募说明书风险揭示部分。

针对上述各种风险，基金管理人建立了一套完整的风险管理体系，具体包括以下内容：

（1）搭建风险管理环境。具体包括制定风险管理战略、目标，设置相应的组织机构、建立清晰的责任线路和报告渠道、配备适当的人力资源、开发适用的技术支持系统等内容。

（2）识别风险。辨识公司运作和基金管理中存在的风险。

（3）分析风险。检查存在的控制措施，分析风险发生的可能性及其引起的后果并将风险归类。

（4）度量风险。评估风险水平的高低，既有定性的度量手段，也有定量的度量手段，定性的度量是把风险水平划分为若干级别，每一种风险按其发生的可能性与后果的严重程度分别进入相应的级别。定量的方法则是设计一些风险指标，测量其数值的大小。

（5）处理风险。将风险水平与既定的标准相对比，对于那些级别较低、在公司所定标准范围以内的风险，控制相对宽松一点，但仍加以定期监控，以防其超过预定标准；而对较为严重的风险，则制定适当的控制措施；对于一些后果可能极其严重的风险，则除了严格控制以外，还准备了相应的应急处理措施。

（6）监视与检查。对已有的风险管理系统进行实时监视，并定期评价其管理绩效，在必要时结合新的需求加以改变。

（7）报告与咨询。建立风险管理的报告系统，使公司股东、公司董事会、公司高级管理人员及监管部门及时而有效地了解公司风险管理状况，并寻求咨询意见。

2、内部控制制度

（1）内部风险控制原则

健全性原则。内部控制机制必须覆盖公司的各项业务、各个部门和各级岗位，并渗透到决策、执行、监督、反馈等各个环节；

有效性原则。通过设置科学清晰的操作流程，结合程序控制，建立合理的内控程序，维护内部控制制度的有效执行；

独立性原则。公司必须在精简高效的基础上设立能充分满足公司经营运作需要的部门和岗位，各部门和岗位在职能上保持相对独立性；公司固有财产、各项委托基金财产、其他资产分离运作，独立进行；

相互制约原则。内部部门和岗位的设置必须权责分明、相互制约，并通过切实可行的相互制衡措施来消除内部控制中的盲点；

防火墙原则。公司基金管理、交易、清算登记、信息技术、研究、市场营销等相关部门，应当在物理上和制度上适当隔离；对因业务需要必须知悉内幕信息的人员，应制定严格的批准程序和监督防范措施；

成本效益原则。公司应当充分发挥各部门及每位员工的工作积极性，尽量降低经营运作成本，保证以合理的控制成本达到最佳的内部控制效果；

合法合规性原则。公司内控制度应当符合国家法律、法规、规章制度和各项规定，并在此基础上遵循国际和行业的惯例制订；

全面性原则。内部控制制度必须涵盖公司经营管理的各个环节，并普遍适用于公司每一位员工，不留有制度上的空白或漏洞；

审慎性原则。公司内部控制的核心是风险控制，内部控制制度的制订要以审慎经营、防范和化解风险为出发点；

适时性原则。内部控制制度的制订应当具有前瞻性，并且必须随着公司经营战略、经营方针、经营理念等内部环境的变化和国家法律法规、政策制度等外部环境的改变及时进行相应的修改或完善。

（2）内部风险控制的要求和内容

内部风险控制要求不相容职务分离、建立完善的岗位责任制和规范的岗位管理措施、建立完整的信息资料保全系统、建立授权控制制度、建立有效的风险防范系统和快速反应机制。

内部风险控制的内容包括投资管理业务控制、市场管理业务控制、信息披露控制、信息技术系统控制、会计系统控制、档案管理控制、建立保密制度以及内部稽核控制等。

（3）督察长制度

公司设督察长，督察长由公司总经理提名，董事会聘任，并应当经全体独立董事同意。督察长的任免须报中国证监会核准。

督察长应当定期或者不定期向全体董事报送工作报告，并在董事会及董事会下设的相关专门委员会定期会议上报告基金及公司运作的合法合规情况及公司内部风险控制情况。督察长发现基金及公司运作中存在问题时，应当及时告知公司总经理和相关业务负责人，提出处理意见和整改建议，并监督整改措施的制定和落实；公司总经理对存在问题不整改或者整改未达到要求的，督察长应当向公司董事会、中国证监会及相关派出机构报告。

（4）监察稽核及风险管理制度

监察稽核部和风险管理部依据公司的内部控制制度，在所赋予的权限内，按照所规定的程序和适当的方法，进行公正客观的检查和评价。

监察稽核部和风险管理部负责调查评价公司内控制度的健全性、合理性；负责调查、评价公司有关部门执行公司各项规章制度的情况；评价各项内控制度执行的有效性，对内控制度的缺失提出补充建议；进行日常风险监控工作；协助评价基金财产风险状况；负责包括基金经理离任审查在内的各项内部审计事务等。

3、基金管理人关于内部控制制度的声明书

（1）基金管理人承诺以上关于内部控制制度的披露真实、准确；

（2）基金管理人承诺根据市场变化和基金管理人发展不断完善内部合规控制。

三、基金托管人

（一）基本情况

名称：中国银行股份有限公司（简称“中国银行”）

住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号

首次注册登记日期：1983年10月31日

注册资本：人民币贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹元整

法定代表人：陈四清

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24 号

托管部门信息披露联系人：王永民

传真：（010）66594942

中国银行客服电话：95566

（二）基金托管部门及主要人员情况

中国银行托管业务部设立于1998年，现有员工110余人，大部分员工具有丰富的银行、证券、基金、信托从业经验，且具有海外工作、学习或培训经历，60%以上的员工具有硕士以上学位或高级职称。为给客户提供专业化的托管服务，中国银行已在境内、外分行开展托管业务。

作为国内首批开展证券投资基金托管业务的商业银行，中国银行拥有证券投资基金、基金（一对多、一对一）、社保基金、保险资金、QFII、RQFII、QDII、境外三类机构、券商资产管理计划、信托计划、企业年金、银行理财产品、股权基金、私募基金、资金托管等门类齐全、产品丰富的托管业务体系。在国内，中国银行首家开展绩效评估、风险分析等增值服务，为各类客户提供个性化的托管增值服务，是国内领先的大型中资托管银行。

（三）证券投资基金托管情况

截至2018年3月31日，中国银行已托管660只证券投资基金，其中境内基金623只，QDII基金37只，覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型、FOF等多种类型的基金，满足了不同客户多元化的投资理财需求，基金托管规模位居同业前列。

（四）托管业务的内部控制制度

中国银行托管业务部风险管理与控制工作是中国银行全面风险控制工作的组成部分，秉承中国银行风险控制理念，坚持“规范运作、稳健经营”的原则。中国银行托管业务部风险控制工作贯穿业务各环节，通过风险识别与评估、风险控制措施设定及制度建设、内外部检查及审计等措施强化托管业务全员、全面、全程的风险管控。

2007年起，中国银行连续聘请外部会计会计师事务所开展托管业务内部控制审阅工作。先后获得基于“SAS70”、“AAF01/06”“ISAE3402”和“SSAE16”等国际主流内控审阅准则的无保留意见的审阅报告。2017年，中国银行继续获得了基于“ISAE3402”和“SSAE16”双准则的内部控制审计报告。中国银行托管业务内控制度完善，内控措施严密，能够有效保证托管资产的安全。

（五）托管人对管理人运作基金进行监督的方法和程序

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定，基金托管人发现基金管理人的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当拒绝执行，及时通知基金管理人，并及时向国务院证券监督管理机构报告。基金托管人如发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当及时通知基金管理人，并及时向国务院证券监督管理机构报告。

四、相关服务机构

（一）基金份额发售机构

1、直销机构：

（1）直销柜台

本公司在上海开设直销柜台。

地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道100号上海环球金融中心58楼

邮政编码：200120

直销柜台电话：021－38505731、38505732、021－38505888－301或302

直销柜台传真：021－50499663、50983055

（2）直销e网金

投资者可以通过本公司直销e网金网上交易系统办理本基金的申购、赎回、转换等业务，具体交易细则请参阅本公司网站公告。直销e网金网址：www.fsfund.com。

2、代销机构：

（1）中国银行股份有限公司

办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号中国银行总行办公大楼

法定代表人：田国立

联系电话：95566

客户电话：95566

公司网址：www.boc.cn

（2）中国工商银行股份有限公司

办公地址：北京市西城区复兴门内大街55号

法定代表人：姜建清

联系电话：95588

客户电话：95588

公司网址：www.icbc.com.cn

（3）中国建设银行股份有限公司

办公地址：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼

法定代表人：王洪章

联系电话：95533

客户电话：95533

公司网址：www.ccb.com

（4）交通银行股份有限公司

办公地址：上海市银城中路188号

法定代表人：牛锡明

联系人：曹榕

联系电话：95559

传真：（021）58408483

客户电话：95559

公司网址：www.bankcomm.com

（5）招商银行股份有限公司

办公地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦

法定代表人：李建红

联系人：邓炯鹏

联系电话：95555

客户电话：95555

公司网址：www.cmbchina.com

（6）渤海银行股份有限公司

办公地址：天津市河东区海河东路218号渤海银行大厦

法定代表人：李伏安

联系人：王星

联系电话：400－888－8811

客户电话：95541

公司网址：www.cbhb.com.cn

（7）上海浦东发展银行股份有限公司

办公地址：中国·上海市中山东一路12号

法定代表人：吉晓辉

联系人：阎志杰

联系电话：95528

传真：021－63604196

客户电话：95528

公司网址：www.spdb.com.cn

（8）中信银行股份有限公司

办公地址：北京市东城区朝阳门北大街9号

法定代表人：李庆萍

联系人：王晓琳

联系电话：95558

客户电话：95558

公司网址：bank.ecitic.com

（9）渤海证券股份有限公司

办公地址：天津市南开区云际道立达公寓F座渤海证券

法定代表人：王春峰

联系人：王星

联系电话：400－651－5988

传真：022－28451958

客户电话：4006515988

公司网址：http://www.ewww.com.cn

（10）长城证券股份有限公司

办公地址：深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦16－17层

法定代表人：丁益

联系人：金夏

联系电话：400－666－6888

客户电话：0755－33680000、400 6666 888

公司网址：www.cgws.com

（11）长江证券股份有限公司

办公地址：武汉市新华路特8号长江证券大厦

法定代表人：崔少华

联系人：奚博宇

联系电话：027－65799999

传真：27－85481900

客户电话：95579或4008－888－999

公司网址：www.95579.com

（12）德邦证券股份有限公司

办公地址：上海市福山路500号城建国际中心26楼

法定代表人：姚文平

联系人：刘阳

联系电话：95353

传真：862168767981

客户电话：400－8888－128

公司网址：www.tebon.com.cn

（13）第一创业证券股份有限公司

办公地址：深圳市福田区福华一路115号投行大厦18层

法定代表人：刘学民

联系人：吴军

传真：0755－25838701

客户电话：95358

公司网址：www.firstcapital.com.cn/

（14）东北证券股份有限公司

办公地址：长春市生态大街6666号

法定代表人：李福春

联系人：安岩岩

联系电话：400－600－0686

传真：0431－85096795

客户电话：95360

公司网址：www.nesc.cn

（15）东方证券股份有限公司

办公地址：上海市中山南路318号东方国际金融广场2号楼21－29层

法定代表人：潘鑫军

联系人：黄静

联系电话：95503

传真：021－63326729

客户电话：95503

公司网址：www.dfzq.com.cn

（16）东海证券股份有限公司

办公地址：上海市浦东新区东方路1928号东海证券大厦

法定代表人：赵俊

联系人：王一彦

联系电话：95531

传真：021－50498825

客户电话：95531；400－8888－588

公司网址：www.longone.com.cn

（17）东吴证券股份有限公司

办公地址：苏州工业园区星阳街5号

法定代表人：范力

联系人：郭晶晶

联系电话：400－860－1555

传真：0512－62938527

客户电话：95330

公司网址：www.dwzq.com.cn

（18）光大证券股份有限公司

办公地址：上海市静安区新闸路1508号3楼

法定代表人：薛峰

联系人：姚巍

联系电话：95525

传真：021－22169134

客户电话：95525

公司网址：www.ebscn.com

（19）广发证券股份有限公司

办公地址：广东省广州天河北路大都会广场5、18、19、36、38、39、41、42、43、44楼

法定代表人：孙树明

联系人：黄岚

联系电话：95575

客户电话：95575或致电各地营业网点

公司网址：www.gf.com.cn

（20）国都证券股份有限公司

办公地址：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层

法定代表人：王少华

联系人：李浚

联系电话：400－818－8118

客户电话：400－818－8118

公司网址：www.guodu.com

（21）中国国际金融股份有限公司

办公地址：北京市建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层

法定代表人：丁学东

联系人：吕卓

联系电话：010－65051166

传真：010－65058065

客户电话：400－910－1166

公司网址：www.cicc.com

（22）国金证券股份有限公司

办公地址：四川省成都市东城根上街95号

法定代表人：冉云

联系人：刘婧漪、贾鹏

传真：028－86690126

客户电话：95310

公司网址：www.gjzq.com.cn

（23）国泰君安证券股份有限公司

办公地址：上海市浦东新区银城中路168号上海银行大厦29楼

法定代表人：杨德红

联系人：钟伟锁

联系电话：021－38032284

传真：021－38670666

客户电话：95521

公司网址：www.gtja.com

（24）国信证券股份有限公司

办公地址：深圳市红岭中路1012号国信证券大厦

法定代表人：何如

联系人：周杨

联系电话：95536

传真：0755－82133952

客户电话：95536

公司网址：www.guosen.com.cn

（25）海通证券股份有限公司

办公地址：上海广东路689号

法定代表人：周杰

联系人：李楠

联系电话：95553

客户电话：95553、400－8888－001或拨打各城市营业网点咨询电话

公司网址：www.htsec.com

（26）申万宏源西部证券有限公司

办公地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路358号大成国际大厦20楼2005室

邮编：830002

法定代表人：韩志谦

联系人：王怀春

传真：0991－2301927

客户电话：400－800－0562

公司网址：www.hysec.com

（27）华安证券股份有限公司

办公地址：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路198号财智中心B1座0327室

法定代表人：章宏韬

联系电话：400－809－6518

传真：0551－65161600

客户电话：95318

公司网址：www.hazq.com

（28）华宝证券有限责任公司

办公地址：上海市浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心57楼

邮编：200120

法定代表人：陈林

联系电话：400－820－9898

传真：021－68777822

客户电话：400－820－9898，021－38929908

公司网址：www.cnhbstock.com

（29）华福证券有限责任公司

办公地址：福州市五四路157 号新天地大厦7、8 层

法定代表人：黄金琳

联系电话：0591－96326

客户电话：96326（福建省外请加拨0591）

公司网址：www.hfzq.com.cn

（30）华泰证券股份有限公司

办公地址：南京市建邺区江东中路228号华泰证券广场

法定代表人：周易

联系人：马艺卿

联系电话：95597

客户电话：95597

公司网址：www.htsc.com.cn

（31）江海证券有限公司

办公地址：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路56号

法定代表人：孙名扬

联系人：周俊

联系电话：400－666－2288

传真：0451－82337279

客户电话：400－666－2288

公司网址：www.jhzq.com.cn

（32）平安证券股份有限公司

办公地址：深圳市福田中心区金田路4036号荣超大厦16－20层

法定代表人：谢永林

联系人：周一涵

联系电话：95511

传真：0755－82435367

客户电话：95511－8

公司网址：www.stock.pingan.com

（33）山西证券股份有限公司

办公地址：山西省太原市府西街69号山西国际贸易中心东塔楼

法定代表人：侯巍

联系人：韩笑

联系电话：400－666－1618

传真：0351－8686619

客户电话：400－666－1618、95573

公司网址：www.i618.com.cn

（34）上海证券有限责任公司

办公地址：上海市黄浦区四川中路213号久事商务大厦7楼

法定代表人：李俊杰

联系人：邵珍珍

联系电话：400－891－8918

传真：021－53686100，021－53686200

客户电话：021－962518

公司网址：www.962518.com

（35）申万宏源证券有限公司

办公地址：上海市徐汇区长乐路989号世纪商贸广场45楼

邮编：200031

法定代表人：李梅

联系人：黄莹

联系电话：95523

传真：021－33388224

客户电话：95523、4008895523

公司网址：www.swhysc.com

（36）西南证券股份有限公司

办公地址：重庆市江北区桥北苑8号西南证券大厦

法定代表人：吴坚

联系人：张熙

联系电话：400－809－6096

传真：23－63786212

客户电话：400－8096－096、95355

公司网址：www.swsc.com.cn

（37）信达证券股份有限公司

办公地址：北京市西城区闹市口大街 9 号院1 号楼信达金融中心

法定代表人：张志刚

联系人：付婷

联系电话：400－800－8899

传真：010－63081344

客户电话：95321

公司网址：www.cindasc.com

（38）兴业证券股份有限公司

办公地址：上海市浦东新区长柳路36号兴业证券大厦

法定代表人：兰荣

联系人：乔琳雪

联系电话：95562

客户电话：95562

公司网址：www.xyzq.com.cn

（39）中国银河证券股份有限公司

办公地址：中国北京西城区金融大街35号国际企业大厦C座

法定代表人：陈有安

联系人：辛国政

联系电话：95551

客户电话：95551、400－8888－888

公司网址：www.chinastock.com.cn

（40）招商证券股份有限公司

办公地址：深圳市福田区益田路江苏大厦A座39—45层

法定代表人：宫少林

联系人：黄婵君

联系电话：95565

传真：0755－82943227

客户电话：4008895565或95565

公司网址：www.newone.com.cn

（41）中航证券有限公司

办公地址：南昌市红谷滩新区红谷中大道1619号国际金融大厦A座41楼

法定代表人：王宜四

联系人：孙超

联系电话：400－886－6567

传真：0791－86789414

客户电话：95335

公司网址：www.avicsec.com

（42）中泰证券股份有限公司

办公地址：上海市浦东新区花园石桥路66号东亚银行金融大厦18层

法定代表人：李玮

联系人：许曼华

联系电话：95538

传真：021－20315125

客户电话：95538

公司网址：www.zts.com.cn

（43）中国中投证券有限责任公司

办公地址：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋第18－21层及第04层01.02.03.05.11.12.13.15.16.18.19.20.21.22.23单元

法定代表人：高涛

联系电话：95532

传真：0755－82026539

客户电话：95532或400 600 8008

公司网址：www.china-invs.cn

（44）中信建投证券股份有限公司

办公地址：北京市朝阳门内大街188号

法定代表人：王常青

联系人：许梦园

联系电话：400－888－8108

客户电话：400－8888－108、95587

公司网址：www.csc108.com

（45）中信期货有限公司

办公地址：深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座13层1301－1306室、14层

法定代表人：张皓

联系人：刘宏莹

联系电话：010－60838677

传真：0755－83217421

客户电话：400－990－8826

公司网址：www.citicsf.com

（46）中信证券股份有限公司

办公地址：北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦

法定代表人：张佑君

联系人：马静懿

联系电话：400－889－5548

传真：010－60833739

客户电话：95548

公司网址：www.cs.ecitic.com

（47）中信证券（山东）有限责任公司

办公地址：青岛市市南区东海西路28号龙翔广场东座5层

法定代表人：杨宝林

联系人：陈平

联系电话：95548

传真：0532－85022605

客户电话：95548

公司网址：www.citicssd.com

（48）北京创金启富投资管理有限公司

办公地址：北京市西城区民丰胡同31号5号楼215A

联系人：宋春

客户电话：400－6262－818

公司网址：www.5irich.com

（49）上海好买基金销售有限公司

办公地址：上海市浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦903～906室

客户电话：400－700－9665

公司网址：www.ehowbuy.com

（50）和讯信息科技有限公司

办公地址：北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层

客户电话：400－920－0022

公司网址：www.licaike.com

（51）上海华夏财富投资管理有限公司

客户电话：400－817－6666

（52）上海基煜基金销售有限公司

办公地址：上海市浦东新区银城中路488号太平金融大厦1503室

法定代表人：王翔

客户电话：400－820－5369

公司网址：www.jiyufund.com.cn

（53）深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

办公地址：北京市西城区宣武门外大街28号富卓大厦A座7层

客户电话：400－166－1188

公司网址：http://8.jrj.com.cn

（54）北京肯特瑞财富投资管理有限公司

办公地址：北京市海淀区海淀东三街2号4层401－15

客户电话：4000988511

公司网址：http://kenterui.jd.com

（55）上海联泰资产管理有限公司

办公地址：上海市长宁区福泉北路518号8座3层

客户电话：4000－466－788

公司网址：www.66zichan.com

（56）上海陆金所资产管理有限公司

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼

客户电话：4008219031

公司网址：www.lufunds.com

（57）诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司

办公地址：上海杨浦区秦皇岛路32号C栋 2楼

客户电话：400－821－5399

公司网址：www.noah-fund.com

（58）蚂蚁（杭州）基金销售有限公司

办公地址：浙江省杭州市西湖区万塘路18号黄龙时代广场B座6F

联系电话：4000－776－123

客户电话：4000－776－123

公司网址：http://www.fund123.cn/

（59）南京苏宁基金销售有限公司

客户电话：95177

公司网址：www.snjijin.com

（60）上海天天基金销售有限公司

办公地址：上海市徐汇区龙田路195号3C座9楼

客户电话：400－1818－188

公司网址：www.1234567.com.cn

（61）浙江同花顺基金销售有限公司

办公地址：浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦903室

联系人：张丽瑞

客户电话：4008－773－772

公司网址：www.5ifund.com

（62）上海挖财金融信息服务有限公司

客户电话：021－50810673

公司网址： www.wacaijijin.com

（63）上海万得投资顾问有限公司

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区福山路33号11楼B座

客户电话：400－821－0203

（64）北京新浪仓石基金销售有限公司

办公地址：北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期(西扩)N－1、N－2地块新浪总部科研楼5层518室

客户电话：010－62675369

公司网址：www.xincai.com

（65）宜信普泽投资顾问（北京）有限公司

办公地址：北京市朝阳区建国路88号9号楼15层1809

客户电话：400－6099－200

公司网址：www.yixinfund.com

（66）奕丰金融服务（深圳）有限公司

客户电话：400－684－0500

公司网址：www.ifastps.com.cn

（67）中经北证（北京）资产管理有限公司

办公地址：北京市西城区车公庄大街4号5号楼1层

客户电话：400－600－0030

公司网址：www.bzfunds.com

（68）深圳众禄基金销售股份有限公司

办公地址：深圳市罗湖区梨园路8号HALO广场4楼

联系电话：400－678－8887

客户电话：400－678－8887

公司网址：www.zlfund.cn

（69）珠海盈米财富管理有限公司

办公地址：广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔12楼B1201－1203

客户电话：020－89629099

公司网址：www.yingmi.cn

（70）基煜基金

基金管理人可根据有关法律法规的要求选择其他机构代理销售基金，并及时公告。

（二）注册登记机构：华宝基金管理有限公司（同上）

（三）出具法律意见书的律师事务所

名称：上海市通力律师事务所

住所：上海市银城中路68号时代金融中心19楼

办公地址：上海市银城中路68号时代金融中心19楼

负责人：俞卫锋

联系电话：(86 21) 3135 8666

传真：（86 21）3135 8600

联系人：安冬

经办律师：安冬、孙睿

（四） 会计师事务所和经办注册会计师

名称：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

注册地址：中国上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼

办公地址：中国上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼

执行事务合伙人：杨绍信

联系电话：(021) 23238888

传真：(021) 23238800

联系人：张振波

经办注册会计师：汪棣、张振波

五、基金的名称

本基金名称：华宝量化对冲策略混合型发起式证券投资基金

六、基金的类型

本基金类型：契约型开放式

七、基金的投资目标

在有效控制风险的基础上，运用股指期货等衍生工具对冲市场系统风险，追求基金资产的长期稳健增值。

八、基金的投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。

基金的投资组合比例为：

本基金权益类空头头寸的价值占本基金权益类多头头寸的价值的比例范围在80%－120%之间。其中：权益类空头头寸的价值是指融券卖出的股票市值、卖出股指期货的合约价值及持有的其他可投资的权益类空头工具价值的合计值；权益类多头头寸的价值是指买入持有的股票市值、买入股指期货的合约价值及持有的其他可投资的权益类多头工具价值的合计值。

每个交易日日终，持有的买入期货合约价值和有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的95%。其中：有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等。

在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。

本基金不受证监会《证券投资基金参与股指期货交易指引》第五条第（一）项、第（三）项及第（五）项的限制。

待基金参与融资融券、转融通业务及投资其他品种（包括但不限于：其他基金份额、期权、收益互换等）的相关规定颁布后，基金管理人可以在不改变本基金既有投资策略和风险收益特征并有效控制风险的前提下，经与基金托管人协商一致后，参与该类业务，以提高投资效率及进行风险管理。届时，基金参与融资融券、转融通业务及投资其他品种的风险控制原则、具体